

## FONDO DE INVERSION EN INSTRUMENTOS DE DEUDA

## MEDIANO PLAZO

T. VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
	<b>BPAS 182</b>			<b>204,614,082</b>	<b>9.10 %</b>
IS	BPA182	190103	AAA(mex)	69,948,914	3.11 %
IS	BPA182	180705	AAA(mex)	56,536,875	2.52 %
IS	BPA182	190411	AAA(mex)	40,482,761	1.80 %
IS	BPA182	170629	AAA(mex)	22,225,571	0.99 %
IS	BPA182	180104	AAA(mex)	15,419,960	0.69 %
	<b>Bondes D</b>			<b>275,079,955</b>	<b>12.24 %</b>
LD	BONDESD	171005	AAA(mex)	120,005,321	5.34 %
LD	BONDESD	181213	AAA(mex)	70,079,002	3.12 %
LD	BONDESD	180614	AAA(mex)	69,955,008	3.11 %
LD	BONDESD	181011	AAA(mex)	15,040,625	0.67 %
	<b>Bonos Prot. Ahorro pago Trim.</b>			<b>622,325,733</b>	<b>27.69 %</b>
IQ	BPAG91	171109	AAA(mex)	96,573,565	4.30 %
IQ	BPAG91	180816	AAA(mex)	90,322,928	4.02 %
IQ	BPAG91	180614	AAA(mex)	84,916,468	3.78 %
IQ	BPAG91	170629	AAA(mex)	81,141,498	3.61 %
IQ	BPAG91	181018	AAA(mex)	80,670,364	3.59 %
IQ	BPAG91	170831	AAA(mex)	72,222,518	3.21 %
IQ	BPAG91	181220	AAA(mex)	65,872,869	2.93 %
IQ	BPAG91	180405	AAA(mex)	50,605,522	2.25 %
	<b>Bonos Prot. Ahorro pago mensual</b>			<b>245,144,246</b>	<b>10.91 %</b>
IM	BPAG28	180726	AAA(mex)	115,158,085	5.12 %
IM	BPAG28	180517	AAA(mex)	69,936,761	3.11 %
IM	BPAG28	171123	AAA(mex)	50,054,525	2.23 %
IM	BPAG28	180222	AAA(mex)	9,994,875	0.44 %
	<b>Tit. Deuda de Org. Multilat.</b>			<b>20,053,271</b>	<b>0.89 %</b>
JI	CABEI	1-16	mxAAA	20,053,271	0.89 %
	<b>Udibonos UDIS</b>			<b>310,335,983</b>	<b>13.81 %</b>
S	UDIBONO	220609	AAA(mex)	96,822,928	4.31 %
S	UDIBONO	171214	AAA(mex)	68,948,981	3.07 %
S	UDIBONO	190613	AAA(mex)	49,045,761	2.18 %
S	UDIBONO	201210	AAA(mex)	34,812,930	1.55 %
S	UDIBONO	351122	AAA(mex)	25,975,946	1.16 %
S	UDIBONO	251204	AAA(mex)	24,597,154	1.09 %
S	UDIBONO	281130	AAA(mex)	10,132,282	0.45 %
	<b>Valores paraestatales Rendim.</b>			<b>189,184,233</b>	<b>8.42 %</b>
95	CFE	14	Aa1.mx	44,931,026	2.00 %
95	PEMEX	12	Aa3.mx	27,028,276	1.20 %
95	CEDEVIS	0810U	AAA(mex)	24,493,777	1.09 %
95	FEFA	17	AAA(mex)	22,137,394	0.99 %
95	FEFA	17-2	AAA(mex)	22,128,040	0.98 %
95	PEMEX	14	Aa3.mx	19,626,458	0.87 %
95	CDVITOT	14U	AAA(mex)	15,547,733	0.69 %
95	CFE	15	Aa1.mx	7,627,433	0.34 %
95	FEFA	16-3	AAA(mex)	5,664,095	0.25 %
	<b>Reportos</b>			<b>380,670,401</b>	<b>16.94 %</b>
LD	BONDESD	191003	AAA(mex)	140,624,580	6.26 %
IQ	BPAG91	181018	AAA(mex)	120,022,992	5.34 %
LD	BONDESD	190808	AAA(mex)	120,022,828	5.34 %
	<b>TOTAL CARTERA</b>			<b>2,247,407,903</b>	<b>100.00 %</b>
	<b>ACTIVO NETO</b>			<b>2,246,284,286</b>	
	<b>VAR ESTABLECIDO \$</b>			<b>8,535,880</b>	<b>0.38 %</b>
	<b>VAR OBSERVADO PROMEDIO \$</b>			<b>1,130,286</b>	<b>0.05 %</b>
	<b>Cartera al:</b>		6/15/2017		

EL VALOR EN RIESGO (VAR POR SUS SIGLAS EN INGLÉS) ES CALCULADO UTILIZANDO EL MÉTODO MONTECARLO, CONSIDERANDO 250 PERÍODOS DE HISTORIA Y GENERANDO 1000 ESCENARIOS DE LOS PRINCIPALES FACTORES DE RIESGO QUE AFECTAN EL VALOR DE LOS ACTIVOS QUE COMPONEN LA CARTERA. EL NIVEL DE CONFIANZA REPORTADO ES DEL 95% CON UN HORIZONTE DE 7 DÍAS